

金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰添润定期开放债券
基金主代码	004045
交易代码	004045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 28 日
报告期末基金份额总额	462,224,071.40 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中，本基金以债券为主，通过密切关注债券市场变化，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，在确保资产稳定增值的基础上，

	通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,050,110.32
2.本期利润	2,944,482.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	514,208,786.43
5.期末基金份额净值	1.1125

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.05%	0.08%	0.04%	0.50%	0.01%
过去六个月	2.24%	0.04%	0.91%	0.03%	1.33%	0.01%
过去一年	2.21%	0.07%	0.80%	0.04%	1.41%	0.03%
过去三年	13.09%	0.10%	4.56%	0.04%	8.53%	0.06%
过去五年	19.42%	0.10%	7.38%	0.05%	12.04%	0.05%
自基金合同生效起至今	23.42%	0.10%	8.96%	0.05%	14.46%	0.05%

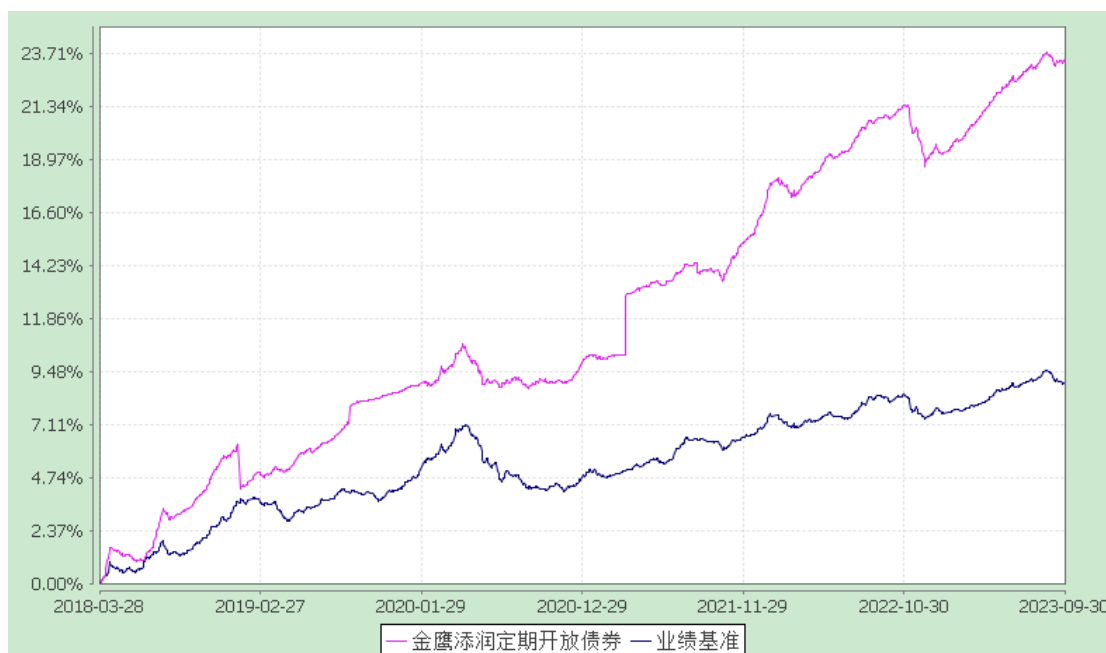
注：1、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

2、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率×80%+1年期银行定期存款利率（税后）×20%。

3、金鹰添润纯债债券型证券投资基金自2018年3月28日起转型为金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金。

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年3月28日至2023年9月30日)



- 注：1、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；
- 2、本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率×80%+1年期银行定期存款利率（税后）×20%。
- 3、金鹰添润纯债债券型证券投资基金自2018年3月28日起转型为金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙悦芳	本基金的基金经理，公司固定收益部总经理	2022-01-27	-	13	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为

根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律、法规及其各项实施准则、本基金基金合同等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度来看，经济复苏的斜率较二季度有所改善。7 月底政治局会议释放稳增长信号后，涉及房地产、地方债务化解、活跃资本市场等各方面的一揽子重磅政策陆续推出，财政政策、货币政策、产业政策协同发力，逆周期调控的力度进

一步加大。财政方面，专项债发行提速，计划外国债发行；货币政策重启逆周期调节，8月超预期降息后，9月降准彰显政策持续用力，支持实体经济的决心；地产方面，包括“认房不认贷”、首套房首付比例、存量首套住房贷款利率在内的多项政策持续优化。金融数据经过第二季度的回落后，8月开始在财政重回扩张的带动下，总量出现超预期回升；但分项来看，7、8月中长贷连续同比少增，社融结构仍有较大改善空间。制造业PMI自6月起连续回升，9月重回荣枯线以上，生产端有所好转，新订单、新出口连续两个月回升，内外需不足的状况也有一定程度的改善。

在经济环比改善和政策预期增强的背景下，债券市场迎来一定幅度的调整，短端调整幅度更大，曲线进一步平坦。整个三季度10年期国债在2.54%-2.70%区间震荡，低点出现在8月，央行超预期降息叠加7月经济数据全线走弱，带动10年国债收益率向下突破2.60%关键点；高点出现在9月末，跨月资金持续收敛，月末公布的8月规模以上工业企业利润由降转增，经济触底回升的态势进一步明朗。1年国债收益率整体上行，由7月中旬的1.73%上行至9月末的2.23%，期限利差被动大幅收窄。受益于“一揽子化债”带来的政策利好，信用利差整体收窄，低等级、短久期城投债利差压缩更为极致，1年期AA等级城投债与国开的利差三季度最低42BP，较7月初下行25BP。

三季度本基金仍以票息策略为主，密切跟踪市场动态，组合整体维持中性久期，对于增量资金，基于“化债”带来的城投短期偿债能力的改善，适度增加了城投资产的占比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为1.1125元，本报告期份额净值增长率为0.58%，同期业绩比较基准增长率为0.08%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应说明预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产
----	----	-------	--------

			的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	648,542,013.99	99.31
	其中：债券	648,542,013.99	99.31
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,504,070.79	0.69
7	其他各项资产	5,932.37	0.00
8	合计	653,052,017.15	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	596,984,172.34	116.10
	其中：政策性金融债	20,636,907.10	4.01
4	企业债券	30,925,195.07	6.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,632,646.58	4.01
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	648,542,013.99	126.12

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2128035	21 华夏银行 02	400,000.00	41,271,342.47	8.03
2	2128037	21 民生银行 01	400,000.00	41,235,197.81	8.02
3	185010	21 海通 11	400,000.00	41,059,929.86	7.99
4	185558	22 中泰 02	400,000.00	40,788,861.37	7.93
5	2226003	22 汇丰银行 01	400,000.00	40,781,814.21	7.93

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行合肥中心支行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的无锡农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局无锡监管分局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行长沙中心支行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的青岛农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会青岛监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,932.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,932.37

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	462,224,310.80
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	239.40
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	462,224,071.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,937,388.19
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,937,388.19
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比	2.15

例 (%)

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份 额总数	发起份额占 基金总份 额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	9,937,38 8.19	2.15%	9,937,38 8.19	2.15%	不少于 3 年
基金管理人高级管理 人员	0.00	-	0.00	-	-
基金经理等人员	0.00	-	0.00	-	-
基金管理人股东	0.00	-	0.00	-	-
其他	0.00	-	0.00	-	-
合计	9,937,38 8.19	2.15%	9,937,38 8.19	2.15%	不少于 3 年

注：本基金的管理人发起资金持有期限已经届满3年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息**9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

投资者类 别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金 情况	
	序号	持有基金份额比 例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额 占比
机构	1	2023年7月3日至 2023年9月28日	452,283,1 29.81	0.00	0.00	452,283,129 .81	97.85 %
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p>							

- 3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；
- 4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

10.3 查阅方式

可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二三年十月二十五日